

## Прогнозирование возможных величин падений/роста российского рынка акций (продолжение 1)

**Бачеров А.В.**  
**10.09.2018**

26.02.2018 года я написал статью [«Прогнозирование возможных величин падений/роста российского рынка акций»](#), в которой продемонстрировал метод предсказаний на основе математической статистики.

В частности, было сделано предсказание, что имеется не малая вероятность, что индекс ММВБ может упасть в район 1900-2100 пунктов в период с марта по май 2018 года. Прогноз оправдался частично в апреле, когда индекс ММВБ достиг 2091. Почему частично? Потому что данное падение носило очень кратковременный характер, и не сформировало тенденции. В связи с тем, что в 10.07.2018 индекс ММВБ поставил новый рекорд достигнув 2379,33 прогноз от 26.02.2018 потребовал настоящего уточнения.

Хотелось бы отметить: если в предыдущей работе выбор экстремумов, на основании которых строились вероятностные распределения, носил в большей степени эмпирически-исторический характер, то в текущей версии расчётов он полностью математизирован и алгоритмирован.

На графике 1 Показаны доверительные площади в может находится индекс ММВБ на основе рассчитанных статистических данных. Графики 2 и 3 визуально отражают плотности распределений в данных областях (жёлтая – наиболее вероятное, синее – наименее). График 4 демонстрирует площади распределений в трехмерном виде. График 5 отображает экстремумы, полученные с помощью математического алгоритма.

График 1



График 2

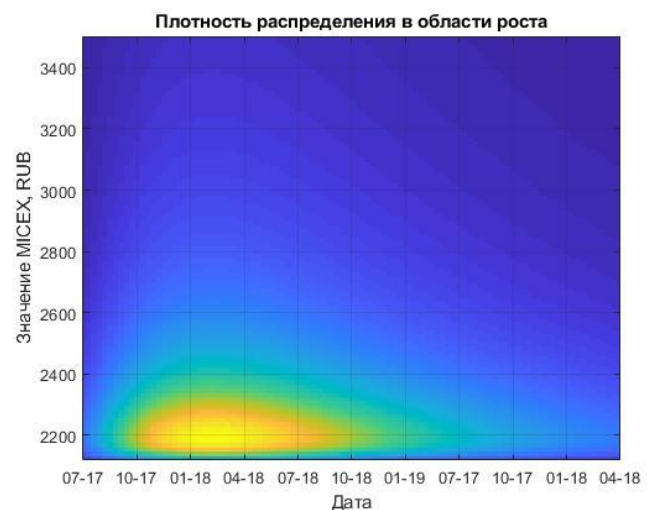


График 3

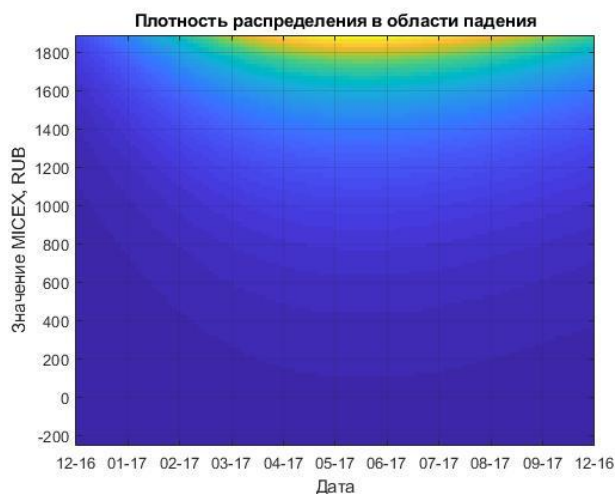
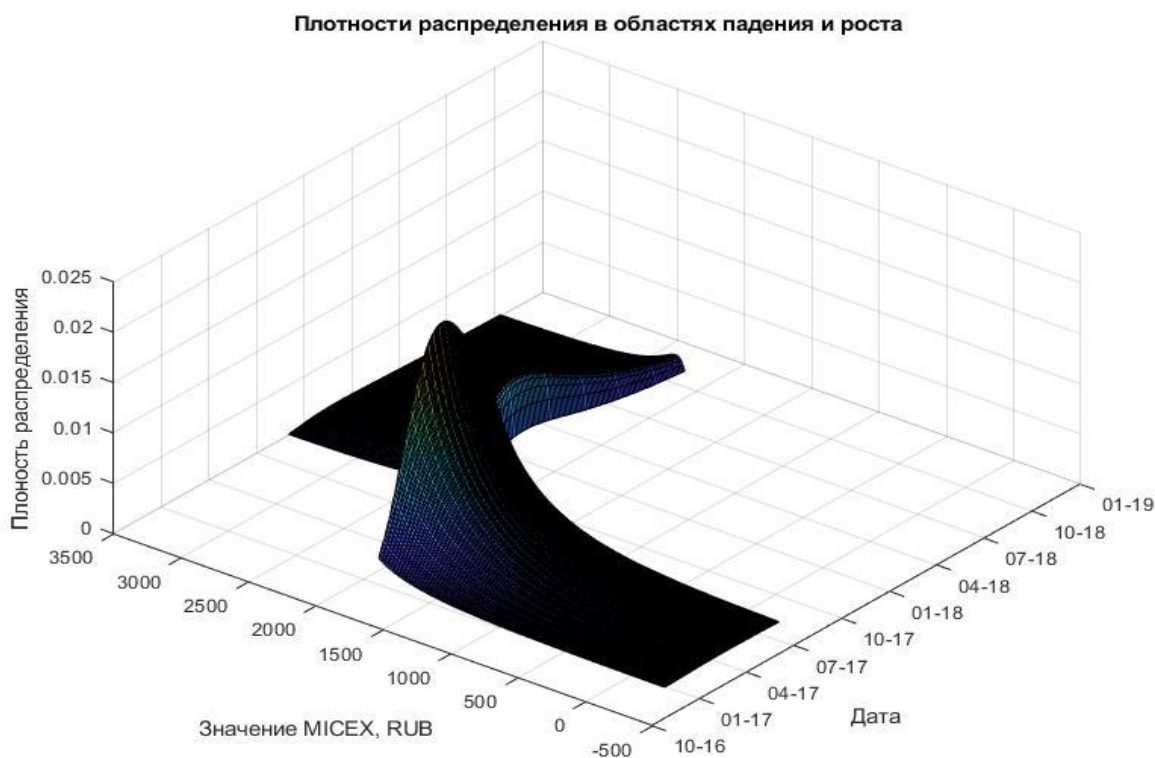


График 5



График 4



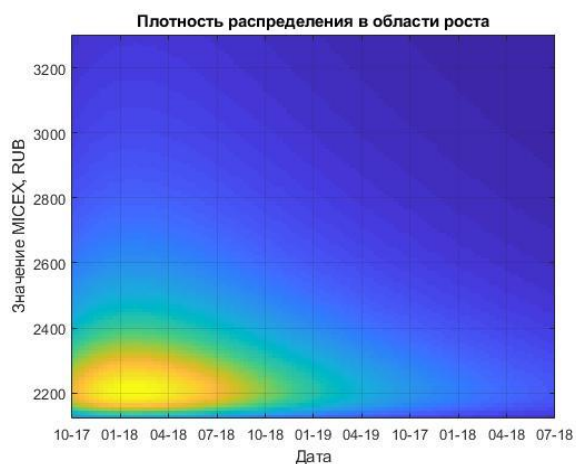
Несложно заметить (график 1 и 2), что индекс ММВБ «уходит» из зоны наиболее вероятных значений.

Если предположить, что 10.07.2018 был достигнут очередной максимум, то весьма вероятно, что индекс ММВБ в ближайшие 6 месяцев может опуститься до 1800 пунктов (смотри график 6, 7, 8, 9), которые демонстрируют те же данные, что и графики 1,2,3,4, но с учётом указанного максимума.

График 6



График 7



Расчёты выполнены в среде MatLab:  
 Falls\_and\_Gross\_ALL  
 fractals\_all

График 8

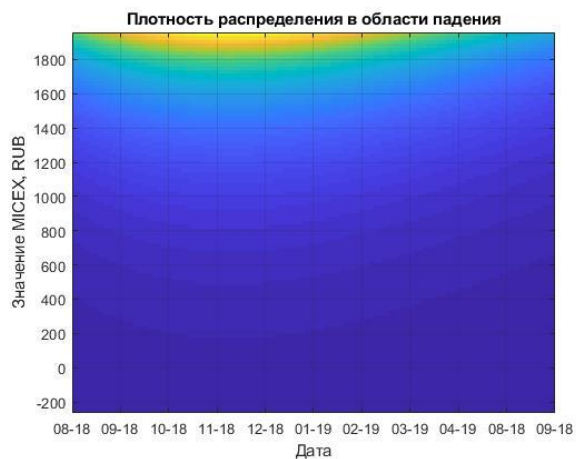


График 9

